

## PRINCIPAL DEUDA 1, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>180,738</b>	<b>8.44 %</b>
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	69,314	3.23 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	56,090	2.62 %
	<b>VARIOS</b>			<b>55,334</b>	<b>2.58 %</b>
	<b>Bondes D</b>			<b>240,190</b>	<b>11.21 %</b>
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	84,916	3.96 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	70,220	3.28 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	70,063	3.27 %
	<b>VARIOS</b>			<b>14,991</b>	<b>0.70 %</b>
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>73,601</b>	<b>3.43 %</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	73,601	3.43 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>563,765</b>	<b>26.31 %</b>
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	103,527	4.83 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	97,214	4.54 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	90,940	4.24 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	81,257	3.79 %
IQ	BPAG91	190822	AAA(mex)	75,561	3.53 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,208	3.04 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,058	2.34 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago mensual</b>			<b>245,650</b>	<b>11.46 %</b>
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	115,426	5.39 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	70,072	3.27 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,140	2.34 %
	<b>VARIOS</b>			<b>10,012</b>	<b>0.47 %</b>
	<b>Cetes</b>			<b>236,842</b>	<b>11.05 %</b>
BI	CETES	180816	AAA(mex)	78,215	3.65 %
BI	CETES	180315	AAA(mex)	56,299	2.63 %
BI	CETES	180301	AAA(mex)	53,531	2.50 %
BI	CETES	180215	AAA(mex)	48,797	2.28 %
	<b>Tit. Deuda de Org. Multilat.</b>			<b>20,142</b>	<b>0.94 %</b>
	<b>VARIOS</b>			<b>20,142</b>	<b>0.94 %</b>
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>154,896</b>	<b>7.23 %</b>
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	59,939	2.80 %
	<b>VARIOS</b>			<b>94,957</b>	<b>4.43 %</b>
	<b>Valores paraestatales Rendim.</b>			<b>161,807</b>	<b>7.55 %</b>
	<b>VARIOS</b>			<b>161,807</b>	<b>7.55 %</b>
	<b>Reportos</b>			<b>265,095</b>	<b>12.37 %</b>
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	165,075	7.70 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	50,010	2.33 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	50,010	2.33 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,142,727</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,171,845</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>8,253</b>	<b>0.38 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>717</b>	<b>0.03 %</b>
	<b>Cartera al:</b>		10/12/2017		

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS